

华兴证券有限公司
华菁全天候量化 1 号集合资产管理计划
清算审计报告
天职业字[2023]38987 号

目 录

清算审计报告	1
清算报表	3
清算事项说明	7



清算审计报告

天职业字[2023]38987号

华菁全天候量化1号集合资产管理计划清算组：

我们审计了后附的华菁全天候量化1号集合资产管理计划（以下简称“贵计划”或“资产管理计划”）清算报表，包括2023年3月27日的清算资产负债表及清算财产表以及2023年3月25日至2023年3月27日的清算损益表及债务清偿表。

一、资产管理计划管理人对清算报表的责任

按照清算事项说明二所述的编制基础编制清算报表是贵计划管理人—华兴证券有限公司的责任。这种责任包括设计、实施和维护与清算报表相关的内部控制，以使清算报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们按照中国注册会计师审计准则计划和执行审计工作，以合理确信这些清算财务报表是否不存在重大错报。审计工作包括在抽查的基础上检查支持这些清算财务报表金额和披露的证据，评价贵计划清算组在编制这些清算财务报表时采用的会计政策和作出的重大会计估计，以及评价这些清算会计报表的整体反映。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，贵计划清算报表已经按照清算事项说明二所述的编制基础编制，在所有重大方面公允地反映了贵计划2023年3月27日的清算资产负债状况以及2023年3月25日至2023年3月27日清算损益及债务清偿情况。

[以下无正文]



清算审计报告（续）

天职业字[2023]38987 号

[此页无正文]



中国注册会计师：



中国注册会计师：





华菁全天候量化1号集合资产管理计划

清算资产负债表

2023年3月27日

金额单位:人民币元

项目	清算开始日	清算结束日
资产		
普通资产:		
银行存款	9,054,227.96	9,054,492.02
结算备付金	3,850,776.74	3,991,042.36
存出保证金	140,294.00	
交易性金融资产		
其中: 股票投资		
债券投资		
基金投资		
权证投资		
资产支持证券投资		
衍生金融工具		
买入返售金融资产		
应收证券清算款		
应收股利		
应收利息		
其他资产		
资产总计	13,045,298.70	13,045,534.38
债务及清算净损益		
普通债务:		
应付赎回款		
应付管理人报酬	63,861.73	63,861.73
应付交易费用		
应付托管费	1,596.57	1,596.57
应付投资顾问费		
应交税费	225.60	225.60
其他负债	16,000.00	16,000.00
债务合计	81,683.90	81,683.90
清算净损益:		
清算净收益(清算净损失以“-”号表示)	12,963,614.80	12,963,850.48
债务及清算净损益总计	13,045,298.70	13,045,534.38



华菁全天候量化1号集合资产管理计划

清算财产表

2023年3月27日

金额单位:人民币元

项目	清算结束日	预计可变现金额
普通财产:		
银行存款	9,054,492.02	9,054,492.02
结算备付金	3,991,042.36	3,991,042.36
存出保证金		
交易性金融资产		
衍生金融资产		
买入返售金融资产		
应收证券清算款		
应收利息		
应收股利		
应收申购款		
其他资产		
清算财产总计	13,045,534.38	13,045,534.38



华菁全天候量化1号集合资产管理计划

清算损益表

2023年3月25日至2023年3月27日

金额单位:人民币元

项目	本期数
一、清算收益 (清算损失以“-”号表示)	
1、利息收入	628.94
2、投资收益	-743.26
3、公允价值变动收益	350.00
清算收入小计	235.68
二、清算支出	
1、托管费	
2、管理人报酬	
3、清算费用	
其中:其他费用	
清算支出小计	
三、本期清算净收益 (清算损失以“-”号表示)	235.68
四、从持有人权益转入	12,963,614.80
五、累计清算净收益 (清算净损失以“-”号表示)	12,963,850.48



华菁全天候量化1号集合资产管理计划

债务清偿表

2023年3月25日至2023年3月27日

金额单位：人民币元

项目	清算开始日	本期增加	本期减少	清算结束日	本期以现金清偿
普通债务：					
应付赎回款					
应付管理人报酬	63,861.73			63,861.73	
应付交易费用					
应付托管费	1,596.57			1,596.57	
应付投资顾问费					
应交税费	225.60			225.60	
其他负债	16,000.00			16,000.00	
债务合计	81,683.90			81,683.90	



华菁全天候量化 1 号集合资产管理计划

2023 年 3 月 25 日至 2023 年 3 月 27 日

清算事项说明

(除另有说明外, 以人民币元为货币单位)

一、华菁全天候量化1号集合资产管理计划简介

(一) 基本情况

华菁全天候量化 1 号集合资产管理计划(以下简称“本计划”或“本资管计划”)已向中国证券投资基金业协会备案, 于 2017 年 1 月 24 日取得中国证券投资基金业协会出具的产品编码为 SQ5062 的资产管理计划备案确认函。本资管计划由华兴证券有限公司作为资产管理人(以下简称“管理人”), 中信证券股份有限公司作为资产托管人(以下简称“托管人”)。本计划于 2017 年 1 月 18 日成立。

本计划设立时募集资金到位情况经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审验, 并由其出具《验资报告》(瑞华验字[2017]01710001 号)。根据验资报告及持有人份额明细表显示: 本计划的募集资金账户确认的金额为人民币 98,202,320.00 元(大写:人民币玖仟捌佰贰拾万贰仟叁佰贰拾元整), 折合集合计划份额为 98,202,320.00 份(含利息转份额 2,320.00 份)。确认的净参与资金金额为 98,202,320.00 元, 确认的认购金额为 98,202,320.00 元, 实收集合资产管理计划份额为 98,202,320.00 份。

本计划投资于银行存款、同业存单, 以及符合《指导意见》规定的标准化债权类资产, 包括但不限于在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的债券、中央银行票据、资产支持证券、债券回购(包括正回购和逆回购)、非金融企业债务融资工具等; 上市公司股票、存托凭证, 以及中国证监会认可的其他标准化股权类资产; 在证券期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的期货及期权合约等标准化商品及金融衍生品类资产; 公开募集证券投资基金(以下简称公募基金), 以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品。

(二) 清算原因

根据《华菁全天候量化 1 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十一节“集合计划终止和清算”第(一)条“各方一致同意, 出现下列情形之一时, 本集合计划应当终止”第 4 点: “经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的, 资产管理合同应当终止”。截止 2023 年 3 月 24 日, 经本资管计划管理人、托管人和全体委托人书面协商一致, 本资管计划决定终止, 符合上述条款第 4 点, 现决定终止本计划。

（三）清算期间

本计划终止日为 2023 年 3 月 24 日，2023 年 3 月 25 日至 2023 年 3 月 27 日为本计划的清算期间，清算开始日为 2023 年 3 月 25 日，清算结束日为 2023 年 3 月 27 日，资产托管人根据资产管理人出具的划款指令于 T+14 个工作日（T 日为清算基准日）内从资管计划资产支付给指定账户。

二、清算报表编制基础

本计划的会计报表按照会计准则、《华菁全天候量化 1 号集合资产管理计划资产管理合同》《华菁全天候量化 1 号集合资产管理计划说明书》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的专项资产管理业务实务操作的有关规定编制。

（一）费用的确认和计量

1、费用种类

本计划存续期内，作为成本列支由本计划承担的相关费用包括在发生投资交易时按规定比例支付的经手费、证管费、过户费、结算费、印花税、佣金、交易手续费、托管费、管理费、与本计划相关的会计师费、银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、与本计划运营有关的其他费用。

2、费用标准

（1）托管费

本计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 年费率计提。托管人的托管费每日计算，逐日累计，每季度支付一次，由托管人复核无误后根据管理人的指令从集合计划资产中一次性支付给托管人。

（2）管理费

① 固定管理费

本计划的固定管理费按前一日集合计划资产净值的 2.0% 年费率计提。管理人的固定管理费每日计算，逐日累计，每季度支付一次，由托管人复核无误后根据管理人的指令从集合计划资产中一次性支付给管理人。

② 资产管理人的业绩报酬

在本计划分红权益登记日、委托人退出日或计划终止日，管理人将根据委托人的期间年化收益率（R），对期间年化收益率超过 0% 以上部分（不含）按照 20% 的比例收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）。业绩报酬计提日为本计划分红权益登记日、委托人退出日或计划终止日。业绩报酬的计提，以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（以下简称“上一个业绩报酬计提日”，如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提，推广期参与的，以本计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内参与的，以参与当日为上一个业绩报酬计提

日，下同）至本次业绩报酬计提日的期间为基准。委托人退出时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔参与份额应收的管理人业绩报酬。业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，但因投资者退出资产管理计划，按照本计划合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。管理人业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不承担复核业绩报酬的责任。

（3）与本计划相关的会计师费

本计划在存续期间发生的审计费用，由本计划承担。

（二）其他事项

银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费，在发生时一次计入集合计划费用；

与本计划运营有关的其他费用，如果金额较小，不影响集合计划份额净值的，或者无法对应到相应会计期间，可以一次计入集合计划费用；如果金额较大，影响集合计划份额净值的，并且可以对应到相应会计期间，应该在该会计期间内按直线法摊销。

本计划成立前的律师费、会计师费和信息披露费等费用，登记结算费，以及存续期发生的与推广有关的费用，不从集合计划资产中列支。

本计划运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

（三）不列入本计划费用的项目

本计划推广期间的费用，以及处理与本计划运作无关的事项发生的费用等不列入本计划费用。

（四）收益分配

1、可供分配利润的构成

本计划收益由债券利息、基金红利、股息、红利、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入构成。

2、集合计划收益分配原则和方式

（1）每一种类的集合计划份额的每一份额享有同等分配权；

（2）集合计划收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

（3）当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

（4）在符合上述分红条件的前提下，本计划可以进行收益分配。本资管计划红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日；

（5）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在法律法规和监管机构允许的范围内，管理人、托管人协商一致，可以对上述收益分配条件和时间进行调整，并在管理人网站上公

告。

华菁全天候量化 1 号集合资产管理计划收益分配方式如下：

(1) 本计划默认分红方式为红利再投资，投资者可以选择现金分红或红利再投资分红方式。委托人同意遵守登记结算机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制订的规则）。管理人分红时以登记结算机构登记的分红方式为准。

(2) 委托人选择采取默认红利再投资形式的，分红资金按分红除权日的集合计划每份额净值（免收参与费用）转成集合计划份额。集合计划份额计算要保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入本计划资产的损益。

三、清算情况

2023 年 3 月 23 日，华兴证券有限公司发布了《关于华菁全天候量化 1 号集合资产管理计划提前终止公告》，公告本计划管理人决定于 2023 年 3 月 24 日（含）终止本计划，并于 2023 年 3 月 25 日起进入本计划的清算期。截至 2023 年 3 月 27 日（清算基准日）完成可流通证券资产的变现，全部清算工作按清算原则和清算手续进行，具体清算情况如下：

(一) 截至本次清算基准日，本计划实收资本共计人民币 9,460,943.93 元。

(二) 截至本次清算基准日的未变现资产情况：

1. 本计划未了结的活期存款应计利息 616.14 元，该未了结利息由管理人垫付，管理人将未了结的应收利息于 T+14 个工作日（T 日为清算基准日）内支付至本计划的托管户，待银行实际销户结息后由资产托管人根据管理人出具的划款指令付给管理人，实际销户结息的金額于预估应收利息的差额由管理人承担。

2. 本计划未了结的结算备付金及其应计利息 3,991,042.36 元，其中期货备付金 3,189,051.09 元，期权现货备付金 10,000.00 元已于 3 月 28 日划回托管户，剩余 791,991.27 元由管理人垫付。管理人将款项于 T+14 个工作日（T 日为清算基准日）内支付至本计划的托管户，待结算备付金及其应计利息实际退还后由资产托管人根据管理人出具的划款指令划付给管理人。

(三) 清算机动资金情况

本次清算，由管理人垫付机动资金 1,000.00 元，用于清算期间可能产生的其他费用，管理人将机动资金于 T+14 个工作日（T 日为清算基准日）内支付至本计划的托管户，清算结束后，剩余资金由资产托管人根据管理人出具的划款指令划付给管理人。

(四) 截至资管计划本次清算基准日的负债情况

1. 本计划应付管理费 63,861.73 元，应交税费 225.60 元，凭资产管理人出具的划款指令于 T+30 个工作日（T 日为清算基准日）内从集合计划资产支付给本计划的管理人，划付金額以管理人出具的划款指令为准。本次清算开始日起不再计提管理费。

2. 本计划应付托管费 1,596.57 元，凭资产管理人出具的划款指令于 T+30 个工作日（T 日为清算基准日）内从集合计划资产支付给本计划的托管人，划付金额以管理人出具的划款指令为准。本次清算开始日起不再计提托管费。

3. 本计划其他负债 16,000.00 元，包括年度审计费 8,000.00 元，清算审计费 8,000.00 元，凭资产管理人出具的划款指令于 T+30 个工作日（T 日为审计报告日）内从集合计划资产支付给对本计划出具审计报告的会计师事务所，划付金额以管理人出具的划款指令为准。

四、清算结束日的资产负债及剩余财产分配情况

截至计划清算结束日，本计划可分配资产总额为 12,963,850.48 元，其中：银行存款 8,972,808.12 元，存出保证金 3,991,042.36 元。

资产托管人根据资产管理人出具的划款指令于 T+14 个工作日（T 日为清算基准日）内从资管计划资产支付给指定账户，根据本资管计划合同约定，管理人将全部可分配清算资产按全体委托人份额的占比分配给委托人。委托人可分配清算资产人民币 12,701,369.56 元，应付管理人业绩报酬为人民币 262,480.92 元，在本资管计划清算资产支付日将由托管行根据管理人的指令分别划付指定账户。

五、其他重要事项

本计划无其他重要事项。



姓名 丁启新
Full name _____
性别 男
Sex _____
出生日期 1981-01-09
Date of birth _____
工作单位 天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)上海分所
Working unit _____
身份证号码 370112198101097413
Identity card No. _____

天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)
与原件核对一致
(II)

年度检验登记

Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年。
This certificate is valid for another year after



证书编号: 110002410552
No. of Certificate

批准注册协会: 上海市注册会计师协会
Authorized Institute of CPAs

发证日期: 200年 04月 28日
Date of Issuance

丁启新(110002410552)
您已通过2021年年检
上海市注册会计师协会
2021年10月30日

年 月 日
/y /m /d



姓名	户永红
Full name	_____
性别	女
Sex	_____
出生日期	1984-10-10
Date of birth	_____
工作单位	天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)上海分所
Working unit	_____
身份证号码	410421198410101100
Identity card No.	_____

天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)
 与原件核对一致
 (II)

年度检验登记
Annual Renewal Registration

本证书经检验合格，继续有效一年。
This certificate is valid for another year after this renewal.



户永红(110101500006)
您已通过2020年年检
上海市注册会计师协会
2020年08月31日



户永红(110101500006)
您已通过2021年年检
上海市注册会计师协会
2021年10月30日

年度检验登记
Annual Renewal Registration

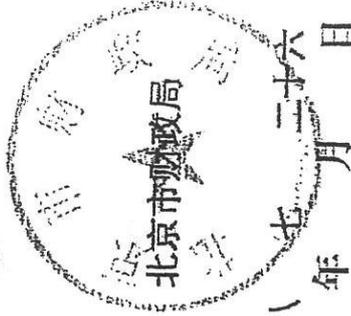
本证书经检验合格，继续有效一年。
This certificate is valid for another year after this renewal.

年 月 日
/y /m /d

证书序号: 0000175

说明

- 1、《会计师事务所执业证书》是证明持有人经财政部门依法审批，准予执行注册会计师法定业务的凭证。
- 2、《会计师事务所执业证书》记载事项发生变动的，应当向财政部门申请换发。
- 3、《会计师事务所执业证书》不得伪造、涂改、出租、出借、转让。
- 4、会计师事务所终止或执业许可注销的，应当向财政部门交回《会计师事务所执业证书》。



发证机关:

二〇一一年

七月二十六日

中华人民共和国财政部制

会计师事务所

执业证书

天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）

名称:

邱靖之

首席合伙人:

主任会计师:

经营场所:

北京市海淀区车公庄西路19号68号楼A-1和A-5区域

特殊普通合伙

组织形式:

11010150

执业证书编号:

京财会许可[2011]0105号

批准执业文号:

2011年11月14日

批准执业日期:

天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)
与原件核对一致
(II)